



Финансиски извештаи

За работењето на Отворен доброволен пензиски фонд

НЛБ Пензија плус

За првите три месеци од 2016 година



NLB

Нов пензиски фонд

Содржина

1.	Извештај за нето средства на НЛБ Пензија плус	3
2.	Извештај за работењето на НЛБ Пензија плус	4
3.	Извештај за промени на нето средствата на НЛБ Пензија плус	5
4.	Финансиски показатели според сметководствените единици	6
5.	Извештај за бројот на сметководствени единици	7
6.	Извештај за структура на инвестициите	8
7.	Структура на инвестициите на НЛБ Пензија плус	14
8.	Извештај за реализирани добивки и загуби	15
9.	Извештај за нереализирани добивки и загуби	18

1. Извештај за нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија плус на ден 31.3.2016

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.03.2015 (во 000 ден.)	31.03.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
1	10	Парични средства	3	1.978	2.684
2	11	Побарувања од продажба на хартии од вредност		0	488
3	12	Побарувања по основ на вложувања		13	15
4	13	Побарувања од Фондот на ПИОМ		0	0
5	14	Побарувања од други пензиски фондови		0	4
6	15	Побарувања за дадени аванси		0	0
7	16	Побарувања од пензиските друштва или чуварот на имот		0	0
8	17	Побарувања од државата и други институции		0	0
9	18	Побарувања за хартии од вредност купени директно од издавачот		0	0
10	19	Платени трошоци за идните периоди и недостасана наплата на приходи (ABP)		0	0
11		Вложувања во хартии од вредност и депозити (12+13+14)	4	269.284	351.158
12	3	Финансиски средства кои се чуваат за тргување		115.875	148.138
13	4	Финансиски средства кои се расположливи за продажба		122.084	162.580
14	5	Финансиски средства кои се чуваат до достасување		31.325	40.440
15		ВКУПНО СРЕДСТВА (збир од 1 до 11)		271.275	354.349
16	20	Обврски за неконвертирани придонеси		0	0
17	21	Обврски по основ на вложување во хартии од вредност, депозити и пласмани		1.070	31
18	22	Обврски за исплата на пензии/пензиски надоместоци спрема членовите на пензискиот фонд - достасани и неисплатени		173	0
19	23	Обврски за пренос на средства на други пензиски фондови по основ на промена на членство		13	0
20	24	Краткорочни обврски за заеми и кредити		0	0
21	25	Долгорочни обврски за заеми и кредити		0	0
22	26	Обврски кон пензиското друштво	5	274	375
23	27	Обврски за брокерски и посреднички провизии		2	1
24	28	Останати обврски на пензискиот фонд		2	19
25	29	Пасивни временски разграничувања		0	0
26		ВКУПНИ ОБВРСКИ (збир од 16 до 25)		1.534	426
27		НЕТО СРЕДСТВА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15 - 26)		269.741	353.923
28		Број на издадени сметководствени единици		1.830.216,887209	2.431.156,551491
29		ВРЕДНОСТ НА СМЕТКОВОДСТВЕНАТА ЕДИНИЦА (27/28)		147,382346	145,578197
30	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси од членови на фондот		233.626	325.357
31	91	Парични приливи по основ на пренос на средства од други фондови од промена на членство		1	431
32	92	Парични одливи по основ на исплатени пензии односно пензиски надоместок		-10.966	-15.188

33	93	Парични одливи по основ на преноси на средства во други фондови од промена на членство		-145	-409
34	94	Добивка/Загуба од тековната финансиска година		11.379	-4.204
35	95	Акумулирана добивка/загуба од претходните години		35.216	47.348
36	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	6	630	588
37		ВКУПНО ОБВРСКИ ВО ОДНОС НА ИЗВОРИТЕ НА СРЕДСТВА (збир од 30 до 36)		269.741	353.923

2. Извештај за работењето на ОДПФ НЛБ Пензија плус на 31.03.2016 година

реден број	Група на сметки или сметка	ПОЗИЦИЈА	Белешки	31.03.2015 (во 000 ден.)	31.03.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5	6
		ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА			
1	70	Приходи од камати и Амортизација на премијата/дисконтот на хартиите од вредност кои достасуваат на фиксен датум	7	1.619	1.903
2	71	Приходи од дивиденди	8	150	234
3	73	Реализирани капитални добивки	9	1.112	59
4	74 - (741+742)	Позитивни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		511	319
5	75	Други неспоменати приходи		0	0
6		ВКУПНО ПРИХОДИ ОД ВЛОЖУВАЊА (збир од 1 до 5)		3.392	2.515
		РАСХОДИ			
7	60	Трошоци од работење со пензиското друштво и чуварот на имот	10	769	1.022
8	61	Расходи по основ на камати		0	0
9	63	Реализирани капитални загуби	11	108	0
10	64 - (641+642)	Негативни курсни разлики од монетарни ставки без финансиските инструменти		394	262
11	65	Расходи за брокерски провизии и останати посреднички трошоци	12	36	16
12	66	Загуба поради оштетување		0	0
13	69	Други расходи		0	0
14		ВКУПНО РАСХОДИ (збир од 7 до 13)		1.307	1.300
15		НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (6-14)		2.085	1.215
16	72-62	Нереализирана капитална добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	13	9.107	-5.684
17	(741+742) - (641+642)	Нето курсни разлики од вложување во финансиски инструменти		187	265
18		ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ/ЗАГУБИ ОД ВЛОЖУВАЊА ВО ХАРТИИ ОД ВРЕДНОСТ (16+17)		9.294	-5.419
19		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (15+18)		11.379	-4.204

**3. Извештај за промени на нето средствата на ОДФ НЛБ Пензија
плус во периодот 01.01.2016 до 31.03.2016 година**

Ознака на позиција	Група на сметки	П О З И Ц И Ј А	31.03.2015 (во 000 ден.)	31.03.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4	5
		НЕТО ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД РАБОТЕЊЕ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД		
1	Образец 2 позиција 15	НЕТО ДОБИВКА/ЗАГУБА ОД ВЛОЖУВАЊА	2.085	1.215
2	Образец 2 позиција 18	Вкупно нереализирана добивка/загуба од вложувања во хартии од вредност	9.294	-5.419
3	96	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	-80	-163
4		ЗГОЛЕМУВАЊЕ/НАМАЛУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (1+2+3)	11.299	-4.367
5	90	Парични приливи по основ на уплатени придонеси	16.905	21.094
6	91	Парични приливи на средства од други пензиски фондови од промена на членство	1	430
7	92	Парични одливи по основ за исплатени пензии/пензиски надоместок	-1.909	-1.387
8	93	Парични одливи на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-20	0
9		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА ОД ТРАНСАКЦИИ СО СМЕТКОВОДСТВЕНИТЕ ЕДИНИЦИ НА ПЕНЗИСКИОТ ФОНД (5+6+7+8)	14.977	20.137
10		ВКУПНО НАМАЛУВАЊЕ/ЗГОЛЕМУВАЊЕ НА НЕТО СРЕДСТВАТА (4+9)	26.276	15.770
		НЕТО СРЕДСТВА		
11		На почетокот на периодот	243.465	338.153
12		На крајот на периодот (10+11)	269.741	353.923
		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ		
13		Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси	116.269,870151	145.796,407054
14		Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство	8,437218	2.957,517618
15		Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии / пензиски надоместоци	-13.278,261287	-9.605,774474
16		Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	-138,622282	0,000000
17		БРОЈ НА СМЕТКОВОДСТВЕНИ ЕДИНИЦИ (13+14+15+16)	102.861,423800	139.148,150198

4. Финансиски показатели според сметководствените единици за периодот 01.01-31.03.2016

Ознака на позиција	ПОЗИЦИЈА	31.03.2015 (во 000 ден.)	31.03.2016 (во 000 ден.)
1	2	3	4
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на почетокот на периодот		
1	Нето средства на пензискиот фонд на почетокот на периодот	243.465	338.153
2	Број на сметководствени единици на почетокот на периодот	1.727.355,463409	2.292.008,401293
3	Вредност на сметководствената единица на почетокот на периодот (1/2)	140,946772	147,535595
	Вредноста на нето средствата на пензискиот фонд по сметководствена единица на крајот на периодот		
4	Нето средства на пензискиот фонд на крајот на периодот	269.741	353.923
5	Број на сметководствени единици на крајот на периодот	1.830.216,887209	2.431.156,551491
6	Вредност на сметководствената единица на крајот на периодот (4/5)	147,382346	145,578197
	ДОПОЛНИТЕЛНИ ПОКАЗАТЕЛИ И ПОДАТОЦИ		
7	Однос помеѓу расходите ¹ и просечните нето средства на пензискиот фонд ²	0,003083	0,003005
8	Однос помеѓу нето добивката/загубата од вложувањата на пензискиот фонд и просечните нето средства на пензискиот фонд ³	0,007985	0,003518
9	Стапка на принос на пензискиот фонд ⁴	7,05%	5,68%

¹ Показателот се добива кога збирот од позициите 7 и 11 од Образецот бр. 2 ќе се подели со просечните нето средства на пензискиот фонд.

² Просечните нето средства на пензискиот фонд се добиваат кога збирот на вредностите на нето средствата на пензискиот фонд од последниот пресметковен ден од месеците во периодот кој е предмет на анализа ќе се подели со бројот на месеците

261.125

345.370

³ Показателот се добива кога позицијата 15 од образецот бр.2 ќе се подели со просечните нето средства на пензискиот фонд.

⁴ Се пресметува согласно формулата од Правилникот за проценка на средствата на задолжителните и доброволните пензиски фондови

Реалната стапка на принос за периодот 31.12.2009 - 31.03.2016 сведена на годишно ниво изнесува 3,90%, додека за периодот 31.12.2009-31.03.2015 изнесува 4,84%.

**5. Извештај за бројот на сметководствени единици на ОДФ НЛБ
Пензија плус за периодот 01.01-31.03.2016**

реден број	П О З И Ц И Ј А	Број на сметководствени единици	Извори на средствата на фондот
1	2	3	4
1	На почетокот на периодот	2.292.008,401293	290.055
2	Издадени сметководствени единици врз основа на уплатени придонеси во текот на периодот	145.796,407054	21.094
3	Издадени сметководствени единици врз основа на пренос на средства од други пензиски фондови од промена на членство во текот на периодот	2.957,517618	430
4	Повлечени сметководствени единици врз основа на исплата на пензии/пензиски надоместоци	-9.605,774474	-1.387
5	Повлечени сметководствени единици врз основа пренос на средства во други пензиски фондови од промена на членство	0,000000	0
6	Вкупен број на сметководствени единици на крајот на периодот	2.431.156,551491	310.192
	Вредност на сметководствената единица		
	На почетокот на периодот		147,535595
	На крајот на периодот		145,578197

6. Извештај за структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија плус за периодот 01.01-31.03.2016

(1) Акции

ОПИС	Бр. на акции	Трошок на набавка по акција (во ден.)	Вкупен трошок на набавка (во ден.)	Вредност на акцијата на денот на известување	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6	7	8
Обични акции							
МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.382	5.445	7.524.589	5.200	7.186.400	0,10%	2,03%
МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	16	37.830	605.280	40.000	640.000	0,09%	0,18%
МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.443	490	7.077.070	470	6.788.210	0,47%	1,92%
МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	14.046	290	4.071.093	285	4.003.391	0,01%	1,13%
МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.351	3.850	9.051.350	3.690	8.675.190	0,52%	2,45%
МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	600	2.544	1.526.250	2.330	1.398.000	0,14%	0,39%
МКRRIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	227	27.760	6.301.600	29.000	6.583.000	0,57%	1,86%
МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	157	41.000	6.437.000	38.000	5.966.000	0,60%	1,68%
МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	427	8.990	3.838.759	8.650	3.693.550	0,55%	1,04%
МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.346	2.600	3.499.600	2.500	3.365.000	0,50%	0,95%
Приоритетни акции							
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во Република Македонија			49.932.591		48.298.741		13,63%

Обични акции							
BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	293	7.046	2.064.605	6.740	1.974.847	0,00%	0,56%
CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	484	4.740	2.294.287	3.940	1.907.123	0,00%	0,54%
CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	447	4.161	1.860.023	4.062	1.815.661	0,00%	0,51%
DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	476	5.621	2.675.637	4.979	2.369.872	0,00%	0,67%
DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	362	5.403	1.955.754	5.747	2.080.347	0,00%	0,59%
DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	228	9.866	2.249.481	8.819	2.010.774	0,00%	0,57%
DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	485	4.185	2.029.774	4.090	1.983.808	0,00%	0,56%
FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	379	4.815	1.825.030	4.372	1.656.856	0,00%	0,47%
FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.551	1.490	2.310.959	1.276	1.979.779	0,00%	0,56%
FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	195	8.792	1.714.500	9.285	1.810.571	0,00%	0,51%
FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	750	3.083	2.312.236	2.729	2.046.551	0,00%	0,58%
US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	34	43.860	1.491.235	41.563	1.413.158	0,00%	0,40%
US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	195	8.991	1.753.248	8.168	1.592.823	0,00%	0,45%
US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	373	5.887	2.196.001	5.938	2.214.827	0,00%	0,63%
US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	131	15.894	2.082.049	14.182	1.857.903	0,00%	0,52%
US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	520	2.422	1.259.359	2.527	1.314.232	0,00%	0,37%
US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	390	1.756	684.864	1.732	675.460	0,00%	0,19%
US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	300	1.919	575.695	1.946	583.817	0,00%	0,16%
US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	256	7.427	1.901.247	7.269	1.860.963	0,00%	0,53%
US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	547	3.655	1.999.025	3.226	1.764.818	0,00%	0,50%
US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	580	3.004	1.742.048	3.009	1.745.208	0,00%	0,49%
US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	335	4.898	1.640.775	4.607	1.543.496	0,00%	0,44%
US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	551	3.386	1.865.424	3.253	1.792.133	0,00%	0,51%
US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	256	4.408	1.128.570	4.334	1.109.493	0,00%	0,31%
US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	220	3.509	772.047	3.528	776.200	0,00%	0,22%
US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	700	2.666	1.866.383	2.946	2.062.429	0,00%	0,58%
US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	648	3.007	1.948.827	2.635	1.707.283	0,00%	0,48%

Приоритетни акции							
US02079K1079 - ALPHABET INC -	21	42.781	898.409	40.586	852.296	0,00%	0,24%
Акции во затворени инвестициони фондови							
Вкупно вложувања во акции издадени во странство			49.097.495		46.502.727		13,12%
Вкупно вложувања во акции			99.030.086		94.801.468		26,75%

(2) Обврзници

ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во ден.)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија					
MKMINF20G218 - DO2011/01-0916 29.9.2016 0:0:0 - MKD	2.000.000	2.028.402	2.056.543	0,39%	0,58%
MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	10.000.000	9.980.572	10.046.101	8,33%	2,84%
MKMINF200D50 - RMDEN05 31.5.2016 0:0:0 - EUR	26.624	1.647.284	1.610.775	0,78%	0,45%
MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	149.897	9.230.594	9.313.126	4,16%	2,63%
MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	22.675	1.382.958	1.412.433	0,25%	0,40%
MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	44.352	2.697.244	2.713.479	0,48%	0,77%
MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	365.395	22.143.566	22.262.497	2,44%	6,28%
MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	48.538	2.855.506	2.810.850	0,74%	0,79%
MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	72.602	4.314.617	4.379.099	1,04%	1,24%
MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	44.786	2.600.371	2.686.113	0,43%	0,76%

MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	240.558	14.251.279	14.420.519	2,67%	4,07%
MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	347.194	20.567.877	20.763.694	3,65%	5,86%
MKMINF20G226 - DO2011/02-0916 29.9.2016 0:0:0 - EUR	32.517	2.030.351	2.060.872	0,55%	0,58%
MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	32.521	1.976.762	2.008.080	0,79%	0,57%
MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	48.686	3.083.191	3.129.580	0,26%	0,88%
MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	97.549	6.086.888	6.178.470	4,76%	1,74%
MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	16.260	1.010.434	1.025.637	0,32%	0,29%
MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	48.785	3.021.886	3.067.352	0,59%	0,87%
MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	65.033	4.050.299	4.102.493	0,92%	1,16%
MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	48.763	3.013.586	3.052.421	2,02%	0,86%
MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	19.460	1.199.516	1.214.974	0,39%	0,34%
MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	64.846	3.964.691	4.017.408	1,40%	1,13%
MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	97.274	6.174.627	6.254.195	2,73%	1,77%
MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	102.137	7.067.095	7.143.208	6,67%	2,02%
MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	64.975	4.117.794	4.170.857	2,50%	1,18%
MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	81.066	5.124.329	5.190.362	1,18%	1,46%
MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	97.498	6.136.432	6.221.448	2,33%	1,76%
MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	64.861	3.964.291	4.011.163	0,49%	1,13%
MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	81.242	5.112.207	5.164.489	0,00%	1,46%
MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	64.834	4.060.953	4.102.484	2,06%	1,16%
MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	64.834	4.070.362	4.116.942	0,64%	1,16%
MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	24.313	1.500.405	1.502.827	1,17%	0,42%
MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	24.314	1.500.405	1.500.427	0,93%	0,42%
Обврзници издадени или гарантирани од Народна Банка на Република Македонија					
Обврзници издадени или гарантирани од банки					
Обврзници издадени од акционерски друштва, освен банки					
Вкупно инвестиции во обврзници издадени во Република Македонија			173.710.918		49,02%

Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки					
Обврзници и други хартии од вредност - издадени од странски единици на локална самоуправа					
Обврзници и други должнички хартии од вредност - издадени од странски компании и банки					
Вкупно инвестиции во обврзници издадени во странство			0		0,00%
Вкупно инвестиции во обврзници			173.710.918		49,02%

(3) Други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови

ОПИС	Номинална вредност	Трошок на набавка (во ден.)	Вкупна вредност на денот на известување (во денари)	% на издавачот	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4	5	6
Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија					
Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија					
Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од банки					
Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од банки					
Комерцијални записи издадени од акционерски друштва, освен банки					
Удели во отворени инвестициони фондови					
Други ненаведени хартии од вредност					
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во инвестициони фондови во Република Македонија	0	0	0	0,00%	0,00%
Удели во отворени инвестициони фондови					
DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	889	5.073.702	4.827.009	0,00%	1,36%
US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	325	1.806.300	1.550.186	0,00%	0,44%
US4642865251 - ISHARES MSCI ALL COUNTRY WORLD MINIMUM VOLATILITY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.730	6.755.745	6.926.576	0,01%	1,95%

US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	800	1.091.859	1.053.879	0,01%	0,30%
US4642867562 - ISHARES INC MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.280	3.611.933	3.658.175	0,02%	1,03%
US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	600	956.223	888.475	0,00%	0,25%
US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.910	4.296.457	4.079.219	0,00%	1,15%
US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	7.840	5.171.279	4.873.556	0,00%	1,38%
US4642868552 - ISHARES INC - MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.840	2.099.361	1.887.654	0,00%	0,53%
US4642872422 - ISHARES TR IBOX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	200	1.285.449	1.294.684	0,00%	0,37%
US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	557	2.998.286	3.030.034	0,01%	0,86%
US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.780	3.397.730	3.372.825	0,01%	0,95%
US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.110	1.131.054	1.223.385	0,01%	0,35%
US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.816	8.362.173	8.086.552	0,03%	2,28%
US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	641	6.754.901	6.584.941	0,00%	1,86%
Трезорски записи издадени од странски влади					
Благајнички записи издадени од странски централни банки					
Комерцијални записи издадени од странски компании и банки					
Други ненаведени хартии од вредност					
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во инвестициони фондови издадени во странство			53.337.150		15,05%
Вкупно инвестиции во други должнички хартии од вредност и удели во отворени инвестициони фондови			53.337.150		15,05%

(4) Пласмани и депозити

ОПИС	Трошок за набавка (во денари)	Вкупна вредност на денот на извештајот (во денари)	% од вредноста на пензискиот фонд
1	2	3	4
Краткорочни депозити	13.049.793	13.293.322	3,75%
Долгорочни депозити	16.000.000	16.014.946	4,52%
Останати пласмани			
Вкупно пласмани и депозити	29.049.793	29.308.268	8,27%

7. Структура на инвестициите на ОДПФ НЛБ Пензија плус во видови на финансиски средства на ден 31.03.2016

ОПИС	Вкупна вредност на денот на известувањето (во денари)	Процентуален удел во вредноста на пензискиот фонд
Акции	94.801.468	26,75%
Обврзници и други долгорочни должнички хартии од вредност	173.710.918	49,02%
Краткорочни хартии од вредност	0	0,00%
Акции и удели во инвестициони фондови	53.337.150	15,05%
Парични средства	2.683.932	0,76%
Пласмани и депозити	29.308.268	8,27%
Останати средства	507.558	0,14%
Вкупно средства	354.349.293	100,00%

8. Извештај за реализирани добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија плус за период 1.1.- 31.03.2016

Датум на продажба	Продадена хартија од вредност	Бр. на хартии од вредност	Сметководствена вредност	Продажна цена	Реализирана добивка или загуба
1	2	3	4	5	6 (5-4)
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	943	1.935.711	1.994.342	58.631
16.03.2016	US4642862100 - HXU	100	250.133	255.461	5.328
17.03.2016	US4642862100 - HXU	100	250.133	262.078	11.944
28.03.2016	US4642862100 - HXU	100	250.133	258.039	7.905
31.03.2016	US4642862100 - HXU	90	225.120	232.857	7.737
16.03.2016	US78464A1512 - IBND	140	243.086	246.387	3.300
17.03.2016	US78464A1512 - IBND	130	225.723	234.866	9.143
28.03.2016	US78464A1512 - IBND	140	243.086	249.165	6.078
31.03.2016	US78464A1512 - IBND	143	248.295	255.490	7.195
	ВКУПНО РЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ				58.631

Забелешка: Не е дозволено сумарно прикажување по финансиски инструмент, односно се евидентира секоја трансакција

9. Извештај за нереализирани добивки и загуби на ОДФ НЛБ Пензија плус за период 1.1.- 31.03.2016

Датум на последна проценка	ХАРТИЈА ОД ВРЕДНОСТ	Трошок за набавка (во денари)	Објективна вредност	Ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба	Нереализирана добивка или загуба	Нето курсни разлики	Амортизација на дисконтот (премијата) на инструментите кои доспеваат на фиксен датум*	Загуба поради оштетување
1	2	3	4	5	6	7	8	9
	Обични акции издадени во Република Македонија	49.932.591	48.298.741	0	-1.633.850	0	0	0
	МКАЛКА101011 - АЛКАЛОИД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.524.589	7.186.400	0	-338.189	0	0	0
	МКFERS101018 - ФЕРШПЕД АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	605.280	640.000	0	34.720	0	0	0
	МКGRNT101015 - ГД ГРАНИТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	7.077.070	6.788.210	0	-288.860	0	0	0
	МКMTSK101019 - МАКЕДОНСКИ ТЕЛЕКОМ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	4.071.093	4.003.391	0	-67.702	0	0	0
	МКMTUR101018 - МАКЕДОНИЈАТУРИСТ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	9.051.350	8.675.190	0	-376.160	0	0	0
	МКОНВА101012 - ОХРИДСКА БАНКА АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.526.250	1.398.000	0	-128.250	0	0	0
	МКРPIV101019 - ПРИЛЕПСКА ПИВАРНИЦА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.301.600	6.583.000	0	281.400	0	0	0
	МКREPL101013 - РЕПЛЕК АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	6.437.000	5.966.000	0	-471.000	0	0	0
	МКVITA101012 - ВИТАМИНКА АД ПРИЛЕП - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.838.759	3.693.550	0	-145.209	0	0	0
	МКVVTK101013 - ВВ ТИКВЕШ АД СКОПЈЕ - ОБИЧНИ АКЦИИ	3.499.600	3.365.000	0	-134.600	0	0	0
	Приоритетни акции издадени во Република Македонија							
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени во Република Македонија							
	Обични акции издадени од странски компании и банки	48.199.086	45.650.430	0	-2.548.655	0	0	0
	BE0003793107 - ANHEUSER-BUSCH INBEV NV - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.064.605	1.974.847	0	-89.758	0	0	0
	CH0012005267 - NOVARTIS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.294.287	1.907.123	0	-387.164	0	0	0
	CH0038863350 - NESTLE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.860.023	1.815.661	0	-44.362	0	0	0
	DE0005190003 - BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.675.637	2.369.872	0	-305.765	0	0	0

	DE0007236101 - SIEMENS AG - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.955.754	2.080.347	0	124.593	0	0	0
	DE0008404005 - ALLIANZ SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.249.481	2.010.774	0	-238.706	0	0	0
	DE000BASF111 - BASF SE - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.029.774	1.983.808	0	-45.967	0	0	0
	FR0000120578 - SANOFI - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.825.030	1.656.856	0	-168.174	0	0	0
	FR0000120628 - AXA SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.310.959	1.979.779	0	-331.181	0	0	0
	FR0000121014 - LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.714.500	1.810.571	0	96.071	0	0	0
	FR0000131104 - BNP PARIBAS SA - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.312.236	2.046.551	0	-265.685	0	0	0
	US02079K3059 - ALPHABET INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.491.235	1.413.158	0	-78.077	0	0	0
	US0311621009 - AMGEN INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.753.248	1.592.823	0	-160.425	0	0	0
	US0378331005 - APPLE INC. - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.196.001	2.214.827	0	18.825	0	0	0
	US09062X1037 - BIOGEN IDEC INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	2.082.049	1.857.903	0	-224.146	0	0	0
	US1912161007 - THE COCA COLA CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.259.359	1.314.232	0	54.873	0	0	0
	US3696041033 - GENERAL ELECTRIC COMPANY - ОБИЧНИ АКЦИИ	684.864	675.460	0	-9.405	0	0	0
	US4062161017 - HALLIBURTON CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	575.695	583.817	0	8.122	0	0	0
	US4370761029 - HOME DEPOT INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.901.247	1.860.963	0	-40.284	0	0	0
	US46625H1005 - JP MORGAN CHASE & CO. - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.999.025	1.764.818	0	-234.207	0	0	0
	US5949181045 - MICROSOFT CORP. - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.742.048	1.745.208	0	3.160	0	0	0
	US6934751057 - PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.640.775	1.543.496	0	-97.280	0	0	0
	US8552441094 - STARBUCKS CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.865.424	1.792.133	0	-73.291	0	0	0
	US9078181081 - UNION PACIFIC CORP - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.128.570	1.109.493	0	-19.078	0	0	0
	US9182041080 - VF CORPORATION - ОБИЧНИ АКЦИИ	772.047	776.200	0	4.153	0	0	0
	US92343V1044 - VERIZON COMMUNICATIONS INC - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.866.383	2.062.429	0	196.046	0	0	0
	US9497461015 - WELLS FARGO & CO - ОБИЧНИ АКЦИИ	1.948.827	1.707.283	0	-241.544	0	0	0
	Приоритетни акции издадени од странски компании и банки	898.409	852.296	0	-46.113	0	0	0
	US02079K1079 - ALPHABET INC -	898.409	852.296	0	-46.113	0	0	0
	Акции во затворени инвестициони фондови издадени од странски компании и банки							
	Обврзници издадени или гарантирани од Владата на Република Македонија	171.966.775	173.710.918	-162.206	0	251.740	1.654.607	0
	MKMINF20G218 - DO2011/01-0916 29.9.2016 0:0:0 - MKD	2.028.402	2.056.543	0	0	0	28.140	0

	MKMINF20GC46 - DO2015/02-0118 29.1.2018 0:0:0 - MKD	9.980.572	10.046.101	0	0	0	65.529	0
	MKMINF200D50 - RMDEN05 31.5.2016 0:0:0 - EUR	1.647.284	1.610.775	-55.512	0	2.577	16.426	0
	MKMINF200D68 - RMDEN06 31.5.2017 0:0:0 - EUR	9.230.594	9.313.126	-16.511	0	15.343	83.698	0
	MKMINF200D76 - RMDEN07 31.5.2018 0:0:0 - EUR	1.382.958	1.412.433	13.965	0	2.227	13.282	0
	MKMINF200D84 - RMDEN08 31.5.2019 0:0:0 - EUR	2.697.244	2.713.479	-13.832	0	4.073	25.993	0
	MKMINF200D92 - RMDEN09 31.5.2020 0:0:0 - EUR	22.143.566	22.262.497	-121.587	0	35.585	204.934	0
	MKMINF200DA8 - RMDEN10 31.5.2021 0:0:0 - EUR	2.855.506	2.810.850	-79.058	0	4.479	29.922	0
	MKMINF200DB6 - RMDEN11 31.5.2022 0:0:0 - EUR	4.314.617	4.379.099	25.814	0	5.849	32.820	0
	MKMINF200DC4 - RMDEN12 31.5.2023 0:0:0 - EUR	2.600.371	2.686.113	55.906	0	4.176	25.661	0
	MKMINF200DD2 - RMDEN13 31.5.2024 0:0:0 - EUR	14.251.279	14.420.519	33.008	0	22.610	113.623	0
	MKMINF200DE0 - RMDEN14 31.5.2025 0:0:0 - EUR	20.567.877	20.763.694	-4.400	0	32.241	167.976	0
	MKMINF20G226 - DO2011/02-0916 29.9.2016 0:0:0 - EUR	2.030.351	2.060.872	0	0	3.288	27.233	0
	MKMINF20G259 - DO2012/01-0317 26.3.2017 0:0:0 - EUR	1.976.762	2.008.080	0	0	3.376	27.942	0
	MKMINF20G267 - DO2012/02-0617 25.6.2017 0:0:0 - EUR	3.083.191	3.129.580	0	0	4.992	41.396	0
	MKMINF20G382 - DO2012/13-1017 4.10.2017 0:0:0 - EUR	6.086.888	6.178.470	0	0	9.856	81.725	0
	MKMINF20G408 - DO2012/15-1117 1.11.2017 0:0:0 - EUR	1.010.434	1.025.637	0	0	1.636	13.567	0
	MKMINF20G424 - DO2012/17-1117 23.11.2017 0:0:0 - EUR	3.021.886	3.067.352	0	0	4.893	40.573	0
	MKMINF20G754 - DO2013/28-1018DK 3.10.2018 0:0:0 - EUR	4.050.299	4.102.493	0	0	6.556	45.638	0
	MKMINF20G804 - DO2013/33-1218DK 5.12.2018 0:0:0 - EUR	3.013.586	3.052.421	0	0	4.878	33.957	0
	MKMINF20G820 - DO2013/35-1218DK 26.12.2018 0:0:0 - EUR	1.199.516	1.214.974	0	0	1.942	13.516	0
	MKMINF20G887 - DO2014/06-0219DK 27.2.2019 0:0:0 - EUR	3.964.691	4.017.408	0	0	6.717	45.999	0
	MKMINF20G911 - DO2014/09-0519DK 2.5.2019 0:0:0 - EUR	6.174.627	6.254.195	0	0	9.994	69.573	0
	MKMINF20G929 - DO2014/10-0524DK 2.5.2024 0:0:0 - EUR	7.067.095	7.143.208	0	0	11.434	64.679	0
	MKMINF20G937 - DO2014/11-0519DK 15.5.2019 0:0:0 - EUR	4.117.794	4.170.857	0	0	6.665	46.398	0
	MKMINF20G945 - DO2014/12-0619DK 5.6.2019 0:0:0 - EUR	5.124.329	5.190.362	0	0	8.294	57.739	0
	MKMINF20G994 - DO2014/17-0724DK 24.7.2024 0:0:0 - EUR	6.136.432	6.221.448	0	0	9.934	75.082	0
	MKMINF20GD29 - DO2015/10-0330DK 12.3.2030 0:0:0 - EUR	3.964.291	4.011.163	0	0	6.676	40.196	0
	MKMINF20GE02 - DO2015/18-0525DK 21.5.2025 0:0:0 - EUR	5.112.207	5.164.489	0	0	8.271	44.012	0
	MKMINF20GE69 - DO2015/24-0725DK 9.7.2025 0:0:0 - EUR	4.060.953	4.102.484	0	0	6.570	34.961	0
	MKMINF20GE77 - DO2015/25-0730DK 9.7.2030 0:0:0 - EUR	4.070.362	4.116.942	0	0	6.587	39.993	0
	MKMINF20GH82 - DO2016/08-0331DK 17.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.502.827	0	0	0	2.422	0
	MKMINF20GI08 - DO2016/10-0331DK 31.3.2031 0:0:0 - EUR	1.500.405	1.500.427	0	0	22	0	0

	Обврзници издадени или гарантирани од Народна Банка на Република Македонија							
	Обврзници издадени или гарантирани од домашни банки							
	Обврзници издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Обврзници и други хартии од вредност издадени од странски влади и централни банки							
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски единици на локална самоуправа							
	Обврзници и други должнички хартии од вредност издадени од странски компании и банки							
	Трезорски записи издадени од Владата на Република Македонија							
	Благајнички записи издадени од Народна Банка на Република Македонија							
	Сертификати за депозит и комерцијални записи издадени или гарантирани од домашни банки							
	Хартии од вредност врз основа на хипотека издадени од домашни банки							
	Комерцијални записи издадени од домашни акционерски друштва, освен банки							
	Удели во домашни отворени инвестициони фондови							
	Други ненаведени домашни хартии од вредност							
	Трезорски записи издадени од странски влади							
	Благајнички записи издадени странски централни банки							
	Комерцијални записи издадени од странски компании и банки							
	Удели во странски отворени инвестициони фондови	54.792.450	53.337.150	0	-1.455.300	0	0	0
	DE0005933931 - ISHARES CORE DAX UCITS ETF (DE) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.073.702	4.827.009	0	-246.693	0	0	0
	US33733E2037 - FIRST TRUST NYSE ARCA BIOTECHNOLOGY INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.806.300	1.550.186	0	-256.114	0	0	0
	US4642865251 - ISHARES MSCI ALL COUNTRY WORLD MINIMUM VOLATILITY ETF - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.755.745	6.926.576	0	170.832	0	0	0
	US4642867075 - ISHARES MSCI FRANCE ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.091.859	1.053.879	0	-37.981	0	0	0

	US4642867562 - ISHARES INC MSCI SWEDEN ETF REGISTERED SHARES - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.611.933	3.658.175	0	46.242	0	0	0
	US4642867646 - ISHARES MSCI SPAIN CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	956.223	888.475	0	-67.748	0	0	0
	US4642868065 - ISHARES INC.- MSCI GERMANY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	4.296.457	4.079.219	0	-217.237	0	0	0
	US4642868487 - ISHARES MSCI JAPAN INDEX - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	5.171.279	4.873.556	0	-297.722	0	0	0
	US4642868552 - ISHARES INC - MSCI ITALY CAPPED INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.099.361	1.887.654	0	-211.707	0	0	0
	US4642872422 - ISHARES TR IBOX INVESTMENT GRADE CORPORATE BOND ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.285.449	1.294.684	0	9.235	0	0	0
	US4642872919 - ISHARES GLOBAL TECH. ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	2.998.286	3.030.034	0	31.749	0	0	0
	US4642877967 - ISHARES U.S. ENERGY ETF REGISTERED SHARES O.N. - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	3.397.730	3.372.825	0	-24.905	0	0	0
	US46429B6065 - ISHARES TRUST - MSCI POLAND CAPPED INVESTABLE MARKET INDEX FUND - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	1.131.054	1.223.385	0	92.331	0	0	0
	US78463X8487 - SPDR MSCI ACWI EX-US (ETF) - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	8.362.173	8.086.552	0	-275.621	0	0	0
	US9229083632 - THE VANGUARD GROUP - УДЕЛИ ВО ИНВЕСТИЦИОНИ ФОНДОВИ	6.754.901	6.584.941	0	-169.960	0	0	0
	Други ненаведени хартии од вредност издадени од странски влади и компании							
	ВКУПНО НЕРЕАЛИЗИРАНИ ДОБИВКИ И ЗАГУБИ	325.789.311	321.849.535	-162.206	-5.683.918	251.740	1.654.607	0

Забелешка: Вкупната разлика помеѓу објективната (фер) вредност и трошокот на набавка е еднаква вкупно нерелизираниите добивки (загуби) од вложување во хартии од вредност зголемени за ревалоризација на хартиите од вредност расположливи за продажба, нето курсните разлики, амортизацијата на дисконтот (премијата) на средствата кои доспеваат на фиксен датум и загубата поради оштетување, зависно од видот на средството.

* Во позицијата амортизација на дисконт е додадена пресметаната купонска камата на обврзниците со фиксен датум на доспевање.

Обелоденување поврзано со ризикот од промена на каматните стапки

	Рочност на промената на каматните стапки на средствата и обврските во денари						
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 месеци	од 1-5 години	над 5 год	Некаматносни	Фиксни каматни стапки	Вкупно
Средства							
1) Пари и депозити кај банки	2.683.932	0	0	0	0	0	2.683.932
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0	0	0	0	148.138.618	0	148.138.618
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	0	0	0	0	0	162.579.558	162.579.558
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	10.704.847	2.600.000	6.000.000	0	0	21.134.781	40.439.627
5) Останати средства на пензискиот фонд	0	0	0	0	507.558	0	507.558
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	13.388.778	2.600.000	6.000.000	0	148.646.175	183.714.338	354.349.293
Обврски							0
7) Обврски по основ на заеми и кредити							0
8) Останати обврски	0	0	0	0	425.904	0	425.904
9) Вкупно обврски (7+8)	0	0	0	0	425.904	0	425.904
Каматно сензитивен јаз на средствата и обврските (6-9)	13.388.778	2.600.000	6.000.000	0	148.220.272	183.714.338	353.923.389

Обелоденување на ефективните каматни стапки за главните валути на средствата и обврските на пензискиот фонд

	МКД	EUR	USD	CHF	UK Pound
Средства	%	%	%	%	%
Пари и депозити кај банки	0,50	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти расположливи за продавање	3,15	4,18	0,00	0,00	0,00
Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	3,17	4,04	0,00	0,00	0,00
Обврски	%	%	%	%	%
Обврски по основ на заеми и кредити					

Обелоденувања поврзани со ликвидносниот ризик

	Резидуална рочност на достасување на средствата и обврските				
	од 1 до 3 месеци	од 3 до 12 мес.	од 1 до 5 год.	над 5 год.	Вкупно
Средства					
1) Пари и депозити кај банки	2.683.932	0	0	0	2.683.932
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	148.138.618	0	0	0	148.138.618
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	162.579.558	0	0	0	162.579.558
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	10.835.355	2.600.000	16.000.000	11.004.272	40.439.627
5) Останати средства на пензискиот фонд	507.558	0	0	0	507.558
5) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	324.745.020	2.600.000	16.000.000	11.004.272	354.349.293
Обврски					
6) Обврски по основ на заеми и кредити					0
7) Останати обврски	425.904	0	0	0	425.904
8) Вкупно обврски (6+7)	425.904	0	0	0	425.904
Нето ликвидносен јаз на средствата и обврските (5-8)	324.319.116	2.600.000	16.000.000	11.004.272	353.923.389
Кумулативен ликвидносен јаз на средствата и обврските	324.319.116	326.919.116	342.919.116	353.923.388	

Обелоденувања поврзани со ризикот на девизните курсеви

	Валутна структура на средствата и обврските					
	МКД	EUR	USD	GBP	Други	Вкупно
Средства						
1) Пари и депозити кај банки	1.087.697	0	1.553.175	0	43.059	2.683.932
2) Финансиски инструменти кои се чуваат за тргување	48.298.741	22.740.412	73.376.681	0	3.722.784	148.138.618
3) Финансиски инструменти расположливи за продавање	12.102.643	150.476.914	0	0	0	162.579.558
4) Финансиски инструменти кои се чуваат до достасување	21.072.646	19.366.981	0	0	0	40.439.627
5) Останати средства на пензискиот фонд	4.408	0	503.150	-	0	507.558
6) Вкупни средства (1+2+3+4+5)	82.566.136	192.584.308	75.433.005	0	3.765.843	354.349.293
Обврски	422.303	0	3.600	0	0	425.904

Обелоденувања поврзани со оштетувања на финансиските инструменти (кредитен ризик)

	тековен период	предходен период			тековен период	предходен период
1) Пари и депозити кај банки				1) Состојба на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување почетокот на периодот		
2) Финансиски инструменти расположливи за продавање (2=2a+2б)				2) Вложувања во финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување во текот на периодот		
2a) финансиски инструменти расположливи за продавање-должнички				3) Продажби на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување во текот на периодот (се презентира со негативен предзнак)		
2б) финансиски инструменти расположливи за продавање-сопственички (МСС 39 точка 103)				4) Реализирани добивки / (загуби) во текот на периодот		
3) финансиски инструменти кои се чуваат до достасување				5) Нереализирани добивки/ (загуби) во текот на периодот		
4) Вкупно финансиски инструменти тестирани за оштетување (4=1+2+3)				6) Намалување / (Зголемување) на исправката на вредноста во текот на периодот		
5) Исправка на вредноста (се презентира со негативен предзнак)				7) Состојба на финансиски инструменти кои се предмет на тестирање за оштетување крајот на периодот (7=1+2+3+4+5+6)		
6) Состојба на крајот на периодот (6=4+5)						